

创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

2016年12月31日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017年3月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年01月01日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	创金沪港深精选混合
基金主代码	001662
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月24日
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	233,089,922.59
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金积极进行资产配置，深入挖掘受益于国家经济增长和转型过程中涌现出来的持续成长性良好的和业绩稳定增长的优秀企业进行积极投资，充分分享中国经济增长和优化资产配置的成果，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金以“底线思维”为原则，将组合最大回撤风险控制能够在承受的范围之内；抛弃乐观幻想，明确区分主观期望与市场现实。其次要严格考察风险收益比，承担仓位风险要有回报。操作策略方面重点关注四种类型：其一是深V型超跌反弹的机会；其二是主题轮动行情中的分散潜伏/收割兑现策略；其三是密切关注大小市值风格轮动机会，捕捉短暂的大市值风格补涨机会；第四是中小市值个股的个性化超额收益策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+恒生指数收益率×20%+中债总指数（全价）收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		创金合信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	梁绍锋	郭明
	联系电话	0755-23838908	010-66105799
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-868-0666	95588
传真		0755-25832571	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年	2015年8月24日-2015年12月31日
本期已实现收益	1,668,038.33	330,503.29
本期利润	11,168,899.46	-1,109,530.26
加权平均基金份额本期利润	0.0512	-0.0039
本期基金份额净值增长率	7.54%	-0.50%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0335	-0.0052
期末基金资产净值	249,425,352.25	246,970,419.16
期末基金份额净值	1.070	0.995

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

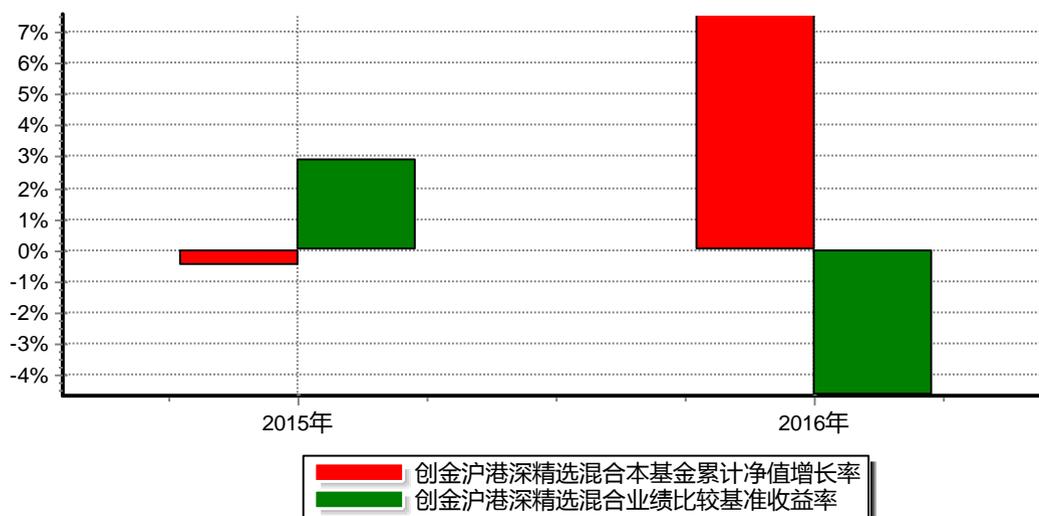
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.86%	0.97%	-1.43%	0.44%	11.29%	0.53%
过去六个月	19.42%	0.93%	2.68%	0.44%	16.74%	0.49%
过去一年	7.54%	1.46%	-4.65%	0.72%	12.19%	0.74%
自基金合同生效日起至今(2015年08月24日-2016年12月31日)	7.00%	1.26%	-1.89%	0.84%	8.89%	0.42%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2015年8月24日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月3日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册设立，注册地为深圳市。公司由第一创业证券股份有限公司、深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）共同出资设立。公司注册资本1.7亿元人民币，股东出资情况为：第一创业证券股份有限公司出资11,900万元，占公司注册资本的70%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资5,100万元，占公司注册资本的30%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。

报告期内，本公司共发行17只公募基金。截至2016年12月31日，本公司共管理24只公募基金，其中混合型产品9只、指数型产品3只、债券型产品8只、股票型产品3只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约142.74亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
张荣	基金经理	2015年8月24日	—	6	张荣先生，中国国籍，北京大学金融学硕士，权益投资基金经理。投资中注重宏观研究，自上而下，把握行业趋势；2004年就职于深圳银监局从事银行监管工作，历任多家银行监管员。2010年加入第一创业证券资产管理部，历任金融行业研究主管、投资主办等职务。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司担任高级研究员，现任基金经理。
李晗	基金经理	2015年8月24日	—	9	李晗先生，中国国籍，中南财经政法大学硕士，金融风险管理师（FRM），权益投资基金经理。投资中注重基本面研究，寻找行业和企业发展的拐点，擅长挖掘估值合理的持续成长股，与优质企业共同成长中获取丰厚回报。曾任职于海航集团从事并购整合业务。此后任职于鹏华基金，从事专户业务、企业年金业务的研究工作。2009年11月加盟第一创业证券资产管理部，曾担任多个集合理财产品投资主办，投资经验丰富。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，现任

					基金经理。
陈玉辉	基金经 理、投资 一部总 监	2015年8月 24日	—	13	陈玉辉先生，中国国籍， 经济学硕士，2003年6月加 入新疆证券有限责任公 司，从事石化行业研究； 2005年度获中央电视台、 中国证券报联合评选的首 届"全国十佳证券分析师 "。2006年1月加入东方证 券股份有限公司研究所， 任化工行业研究员。2008 年3月加入招商基金管理 有限公司，历任研究部副 总监、总监，并于2012年 11月14日至2015年4月10 日担任招商大盘蓝筹股票 型证券投资基金的基金经 理。2015年7月任创金合信 基金管理有限公司投资一 部总监、基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任职日期指公司作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算的起止时间按照从事证券行业开始时间计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规，本公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平交易制度》，该《制度》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资风格库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易室负责异常交易的日常实时监控，监察稽核部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如1日内、3日、5日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《创金合信基金管理有限公司公平交易制度》对本年度同向交易价差、反向交易进行了专项分析，未发现异常交易情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

沪港深研究精选基金成立于2015年8月24日，在成立初期暂时采取类CPPI动态保本策略进行操作，2016年开始参照业绩基准相对收益操作。年初基金重点配置低估值、的银行、钢铁、煤炭等板块，1月经历市场大幅调整后，逐步提高了组合中高贝塔、低市值的化工、建材、有色等周期类行业配置比例。沪港深研究精选基金2016全年坚持“三低”操作策略，主要选择低估值、低涨幅品种进行逢低配置，并逐步用三低品种替换组合配置中涨幅较大的品种。基金整体采取了大、小市值和高、低波动率结合的哑铃型资产配置策略，行业方面重点配置了化工新材料、钢铁、水泥等周期类行业和石化、铁路等国企改革相关个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016年末基金单位净值为1.07元，年度涨幅7.54%。2016年HS300指数下跌11.28%，香港恒生指数微涨0.4%，业绩基准-4.65%，基金涨幅领先业绩基准12.1%。基金净值超越业绩基准的原因主要由于在个股选择和行业配置方面带来一定超额收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济未来较长时期将处于去杠杆过程中，经历长期信用扩张期后，信用杠杆派生的资产泡沫迟早要消化。总资产回报率趋势性下降，导致社会资产负债表自发性的信用收缩，需要货币政策适度对冲。经济L形是由人口、资本等生产要素投入增速趋势性下降决定，但财政政策空间可以阶段性对冲维稳。

A股市场虽然经历了2015年三季度以来持续一年半的调整，但除金融等大盘蓝筹股票表观估值较低外，中小市值和创业板股票整体市盈率、市净率估值仍然处于历史相对

和绝对高位。A股市场未来整体仍将对之前三年牛市累计历史涨幅进行修正，中小市值股票继续振荡回吐相对于大中市值股票的超额收益和相对高估值。参与资金绝对收益止损操作策略趋同，导致之前缓涨急跌的市场特征仍可能阶段性出现。市场缺少全局性机会，仍将是市值指标股整体阶段性轮动振荡维稳，少量中小市值主题、行业局部热点轮动暖场的格局。

行业和主题方面，倾向于供给侧改革、国企改革和一路一带三条主线。2014年以来，国企改革一直是市场顶层运行主线。2016年7月4日全国国有企业改革座谈会上，习近平总书记对国有企业改革作出重要指示，强调理直气壮做强做优做大国有企业。在这一定位明确后，A股市场的主要任务就确定为服务于国企改革、重组、再融资。未来投资标的也将优先在中央和地方国有企业中，选择低估值、低市值、低涨幅的三低品种，逢低配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人在风险控制办公会下设立估值小组，组长由公司总经理担任，成员由基金运营部、研究部、监察稽核部、综合部人员组成，实行一人一票制，可邀请专业人士列席，但不具表决权，基金运营部是估值小组的日常办事机构。估值小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金的管理人--创金合信基金管理有限公司在创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对创金合信基金管理有限公司编制和披露的创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：		
银行存款	54,338,479.72	15,901,846.23

创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2016年年
度报告摘要

结算备付金	358,101.11	21,826,917.00
存出保证金	82,600.56	13,128.52
交易性金融资产	188,257,722.96	166,111,695.90
其中：股票投资	188,257,722.96	166,111,695.90
基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	44,000,000.00
应收证券清算款	—	—
应收利息	6,923.51	14,642.51
应收股利	—	—
应收申购款	21,557,993.62	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	264,601,821.48	247,868,230.16
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	13,748,271.71	213,294.52
应付赎回款	946,340.85	—
应付管理人报酬	226,640.62	325,320.18
应付托管费	37,773.44	54,220.07
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	150,837.46	221,976.23
应交税费	—	—

应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	66,605.15	83,000.00
负债合计	15,176,469.23	897,811.00
所有者权益：		
实收基金	233,089,922.59	248,272,977.05
未分配利润	16,335,429.66	-1,302,557.89
所有者权益合计	249,425,352.25	246,970,419.16
负债和所有者权益总计	264,601,821.48	247,868,230.16

注：1.报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.070元，基金份额总额233,089,922.59份。

2.本财务报表的报告期间为2016年1月1日至2016年12月31日止期间。本基金合同生效日为2015年8月24日，上年度可比期间为2015年8月24日至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年8月24日至2015年12月31 日
一、收入	16,422,962.50	1,024,117.22
1.利息收入	274,543.99	1,933,738.92
其中：存款利息收入	238,070.24	859,031.65
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	36,473.75	1,074,707.27
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	6,312,184.29	348,664.25

其中：股票投资收益	4,718,701.48	348,664.25
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	1,593,482.81	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	9,500,861.13	-1,440,033.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	335,373.09	181,747.60
减：二、费用	5,254,063.04	2,133,647.48
1. 管理人报酬	3,033,909.84	1,511,717.71
2. 托管费	505,651.63	251,953.03
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	1,542,247.77	285,936.74
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	172,253.80	84,040.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	11,168,899.46	-1,109,530.26
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	11,168,899.46	-1,109,530.26

注：本财务报表的报告期间为2016年1月1日至2016年12月31日止期间。本基金合同生效日为2015年8月24日，上年度可比期间为2015年8月24日至2015年12月31日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	248,272,977.05	-1,302,557.89	246,970,419.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	11,168,899.46	11,168,899.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-15,183,054.46	6,469,088.09	-8,713,966.37
其中：1.基金申购款	143,714,005.53	9,625,656.03	153,339,661.56
2.基金赎回款	-158,897,059.99	-3,156,567.94	-162,053,627.93
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	233,089,922.59	16,335,429.66	249,425,352.25
项 目	上年度可比期间 2015年8月24日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	303,868,723.06	—	303,868,723.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-1,109,530.26	-1,109,530.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-55,595,746.01	-193,027.63	-55,788,773.64
其中：1.基金申购款	627,470.04	2,049.90	629,519.94
2.基金赎回款	-56,223,216.05	-195,077.53	-56,418,293.58

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益 (基金净值)	248,272,977.05	-1,302,557.89	246,970,419.16

注：本财务报表的报告期间为2016年1月1日至2016年12月31日止期间。本基金合同生效日为2015年8月24日，上年度可比期间为2015年8月24日至2015年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第1477号《关于准予创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币303,724,280.18元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第987号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年8月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为303,868,723.06份基金份额，其中认购资金利息折合144,442.88份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、权证、股指期货、债券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：沪深300 指数收益率×40%+恒生指数收益率×20%+

中债总指数(全价)收益率×40%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、

财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

7.4.7 关联方关系

7.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

7.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年8月24日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券		—	26,105,899.33	10.77%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券	—	—	—	—
关联方名称	上年度可比期间 2015年8月24日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券	18,933.93	8.64%	18,933.93	8.64%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算

有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年8月24日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,033,909.84	1,511,717.71
其中：支付销售机构的客户维护费	1,768,102.12	950,472.58

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值*1.50%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年8月24日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	505,651.63	251,953.03

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值*0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年8月24日至2015年12月31日
基金合同生效日（2015年8月24日）持有的基金份额	10,010,250.00	10,010,250.00
期初持有的基金份额	10,010,250.00	10,010,250.00
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,010,250.00	10,010,250.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.29%	4.03%

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2016年12月31日		2015年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
第一创业证券股份有限公司	—	—	4,999,450.00	2.01%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年8月24日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	54,338,479.72	210,919.94	15,901,846.23	104,614.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按金融机构同业存款利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新发流通受限	4.00	4.00	22,827	91,308.00	91,308.00
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新发流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新发流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新发流通受限	10.44	10.44	1,764	18,416.16	18,416.16
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新发流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新发流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新发流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新发流通受限	23.16	23.16	748	17,323.68	17,323.68
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新发流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新发流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新发流通受限	21.30	21.30	2,448	52,142.40	52,142.40
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新发流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新发流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66

603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新发流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新发流通受限	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
600859	王府井	2016-09-27	重大资产重组	16.28		—	323,348	5,386,051.60	5,264,105.44

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资

产中属于第一层次的余额为182,604,290.44元，属于第二层次的余额为5,653,432.52元，无属于第三层次的余额(2015年12月31日：第一层次164,750,695.90元，第二层次1,361,000.00元，无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2015年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	188,257,722.96	71.15
	其中：股票	188,257,722.96	71.15
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—

4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金 融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	54,696,580.83	20.67
7	其他各项资产	21,647,517.69	8.18
8	合计	264,601,821.48	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为2,382,437.93元，占净值比为0.96%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	152,180.00	0.06
B	采矿业	—	—
C	制造业	114,758,121.14	46.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,412,320.89	4.17
E	建筑业	15,592.23	0.01
F	批发和零售业	24,838,605.51	9.96
G	交通运输、仓储和邮政业	10,579,603.31	4.24
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	168,880.95	0.07
J	金融业	15,277,461.00	6.13
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	9,672,520.00	3.88
	合计	185,875,285.03	74.52

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

沪港通投资股票行业分类行业类别	沪港通投资股票行业分类公允价值(元)	沪港通投资股票行业分类公允价值占基金资产净值比(%)
A 农、林、牧、渔业	—	—
B 采矿业	720,975.06	0.29
C 制造业	287,674.42	0.12
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E 建筑业	—	—
F 批发和零售业	—	—
G 交通运输、仓储和邮政业	334,904.54	0.13
H 住宿和餐饮业	—	—
I 信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J 金融业	1,038,883.91	0.41
K 房地产业	—	—
L 租赁和商务服务业	—	—
M 科学研究和技术服务业	—	—
N 水利、环境和公共设施管理业	—	—
O 居民服务、修理和其他服务业	—	—
P 教育	—	—
Q 卫生和社会工作	—	—

R 文化、体育和娱乐业	—	—
S 综合	—	—
合计	2,382,437.93	0.96

注：通过沪港通机制投资的股票所属行业分类采用中国证券监督管理委员会制定的《上市公司行业分类指引》。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600731	湖南海利	1,588,819	16,777,928.64	6.73
2	600888	新疆众和	1,788,844	14,006,648.52	5.62
3	000554	泰山石油	1,188,827	13,160,314.89	5.28
4	600883	博闻科技	688,835	11,076,466.80	4.44
5	000422	湖北宜化	1,388,376	11,037,589.20	4.43
6	600509	天富能源	1,388,809	10,374,403.23	4.16
7	000778	新兴铸管	2,002,000	10,350,340.00	4.15
8	000001	平安银行	1,118,830	10,181,353.00	4.08
9	600125	铁龙物流	1,228,057	9,922,700.56	3.98
10	000877	天山股份	1,388,836	9,791,293.80	3.93

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.cjhxfund.com网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600731	湖南海利	30,421,921.81	12.32
2	000422	湖北宜化	29,062,255.61	11.77
3	600328	兰太实业	25,400,095.18	10.28

创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2016年年
度报告摘要

4	600888	新疆众和	23,416,826.27	9.48
5	000554	泰山石油	23,147,534.58	9.37
6	000877	天山股份	18,991,235.23	7.69
7	600509	天富能源	18,479,867.94	7.48
8	000528	柳 工	18,467,237.31	7.48
9	600784	鲁银投资	18,370,509.00	7.44
10	600883	博闻科技	18,126,813.12	7.34
11	000709	河钢股份	18,045,768.63	7.31
12	000876	新 希 望	16,447,669.90	6.66
13	000001	平安银行	16,177,568.15	6.55
14	600586	金晶科技	15,631,312.12	6.33
15	600019	宝钢股份	14,646,323.40	5.93
16	600125	铁龙物流	14,570,037.24	5.90
17	600028	中国石化	13,808,681.77	5.59
18	000731	四川美丰	13,790,073.53	5.58
19	601333	广深铁路	11,010,675.51	4.46
20	000778	新兴铸管	10,512,322.38	4.26
21	600367	红星发展	9,621,376.85	3.90
22	600015	华夏银行	9,223,691.62	3.73
23	600801	华新水泥	9,164,541.10	3.71
24	600859	王府井	9,073,055.53	3.67
25	600123	兰花科创	8,779,816.74	3.56
26	601088	中国神华	8,261,583.00	3.35
27	600068	葛洲坝	7,857,867.00	3.18
28	600005	武钢股份	7,632,884.00	3.09
29	600778	友好集团	7,624,611.10	3.09
30	600192	长城电工	7,604,055.33	3.08
31	601666	平煤股份	7,043,239.10	2.85
32	600108	亚盛集团	6,534,754.01	2.65
33	601998	中信银行	6,507,817.75	2.64

34	600796	钱江生化	6,371,574.99	2.58
35	600426	华鲁恒升	6,239,914.00	2.53
36	600096	云天化	6,226,626.04	2.52
37	600348	阳泉煤业	5,608,984.08	2.27
38	600126	杭钢股份	5,433,449.00	2.20
39	600746	江苏索普	5,170,144.84	2.09

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000422	湖北宜化	23,680,010.95	9.59
2	000731	四川美丰	21,973,980.49	8.90
3	600328	兰太实业	21,900,978.80	8.87
4	600028	中国石化	18,756,811.01	7.59
5	600888	新疆众和	18,113,456.05	7.33
6	600731	湖南海利	17,625,086.04	7.14
7	600019	宝钢股份	17,312,886.99	7.01
8	000001	平安银行	16,743,824.02	6.78
9	000876	新希望	16,408,868.96	6.64
10	600367	红星发展	13,988,900.00	5.66
11	601333	广深铁路	13,874,465.97	5.62
12	600015	华夏银行	13,816,575.54	5.59
13	601998	中信银行	13,251,259.15	5.37
14	000554	泰山石油	12,811,283.00	5.19
15	600509	天富能源	12,752,505.05	5.16
16	000709	河钢股份	12,606,773.02	5.10
17	000877	天山股份	12,532,085.72	5.07
18	600784	鲁银投资	11,725,292.00	4.75
19	601088	中国神华	10,702,529.95	4.33

20	600068	葛洲坝	9,735,512.59	3.94
21	600586	金晶科技	9,025,138.95	3.65
22	000528	柳 工	9,023,281.41	3.65
23	600348	阳泉煤业	8,810,987.86	3.57
24	600192	长城电工	8,776,658.75	3.55
25	600883	博闻科技	8,664,774.88	3.51
26	600108	亚盛集团	8,657,038.81	3.51
27	600123	兰花科创	8,432,019.75	3.41
28	600005	武钢股份	8,356,078.00	3.38
29	600016	民生银行	8,027,902.00	3.25
30	600796	钱江生化	7,878,883.14	3.19
31	600801	华新水泥	7,864,480.21	3.18
32	601328	交通银行	7,338,400.00	2.97
33	600426	华鲁恒升	6,951,040.50	2.81
34	600125	铁龙物流	6,776,063.55	2.74
35	600778	友好集团	6,709,720.51	2.72
36	600746	江苏索普	6,606,032.35	2.67
37	601939	建设银行	6,597,526.42	2.67
38	601666	平煤股份	6,566,829.00	2.66
39	601818	光大银行	6,420,000.00	2.60
40	600096	云天化	6,294,362.85	2.55
41	000983	西山煤电	6,167,361.18	2.50
42	601288	农业银行	6,122,000.00	2.48
43	600126	杭钢股份	5,485,972.55	2.22
44	000635	英 力 特	5,030,917.71	2.04

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	562,381,820.48
卖出股票的收入（成交）总额	554,455,356.03

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

2016年12月17日，湖北宜化公告公司收到宜昌市环境保护局下发的宜市环法[2016]97号文《宜昌市环境保护局行政处罚及停产整治事先(听证)告知书》，处应缴纳排污费数额五倍的罚款，即人民币252万元(大写:贰佰伍拾贰万元)，责令公司停产整治，在停产期间针对存在的环保问题进行整改。

经调查核实,12月2日晚水污染物超标排放原因是老厂区置换过程中造气循环水液位控制不当出现漫液情况导致,属于偶发性事件,我公司于12月2日事发当天已完成整改,并已将整改情况书面报告宜昌市环保局。本次排污事件发生于公司老厂区造气循环水工段,按照原定计划,我公司老厂区生产系统目前已停止生产,进入技术升级改造阶段.本次技改拟将原有的间歇式固定层气化工工艺升级为水煤浆洁净煤气化工艺,可以大幅度降低

污染物排放总量,显著提高公司环保管理水平。公司服从宜昌市环保局拟对我公司进行的行政处罚决定,不对上述行政处罚决定申请陈述申辩和听证。

湖北宜化是中国最大磷肥、氮肥、聚氯乙烯、多元醇等化工品生产商之一,2015年营业收入183亿元,在全国拥有几十套生产装置,因此环保整改和停产的生产能力占其产能比较小。本基金投资湖北宜化主要考虑其化工品业务盈利能力回升,环保处罚对其投资价值判断无实质性影响。公司前期市净率最低仅0.7倍,估值处于历史底部,维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对湖北宜化进行了投资。

8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	82,600.56
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	6,923.51
5	应收申购款	21,557,993.62
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	21,647,517.69

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
4,036	57,752.71	10,010,250.00	4.29%	223,079,672.59	95.71%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,932,138.66	1.26%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年8月24日)基金份额总额	303,868,723.06
本报告期期初基金份额总额	248,272,977.05
本报告期基金总申购份额	143,714,005.53
减：本报告期基金总赎回份额	158,897,059.99
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	233,089,922.59

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用71,999.80元，该审计机构连续提供审计服务的年限为2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	2	460,102,267.29	41.33%	426,637.50	48.00%	
银河证券	2	363,159,931.21	32.62%	263,018.07	29.59%	
国信证券	2	79,299,799.61	7.12%	73,436.31	8.26%	
中信建投	2	39,777,625.10	3.57%	36,659.55	4.12%	
中泰证券	2	50,401,782.	4.53%	36,037.53	4.05%	

		34				
中银国际	2	46,332,829.43	4.16%	33,484.59	3.77%	
金元证券	2	58,392,616.71	5.25%	13,316.93	1.50%	
华安证券	2	14,677,735.90	1.32%	5,430.33	0.61%	
招商证券	2		—	—	—	
中信证券	2		—	—	—	
第一创业证券	2		—	—	—	

注：交易单元的选择标准和程序：

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金报告期内新增中银国际证券，金元证券，招商证券，华安证券，中泰证券5家券商的10个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
东兴证券	—	—	87,000,000.00	60.42%	—	—
银河证券	—	—	30,000,000.00	20.83%	—	—

创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2016年年
度报告摘要

			00.00			
国信证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中银国际	—	—	—	—	—	—
金元证券	—	—	27,000,0 00.00	18.75%	—	—
华安证券	—	—	—	—	—	—
招商证券		—		—		—
中信证券		—		—		—
第一创业证 券		—		—		—

创金合信基金管理有限公司

二〇一七年三月二十七日